ITinvest on-line broker

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

# Ежедневный обзор рынка акций

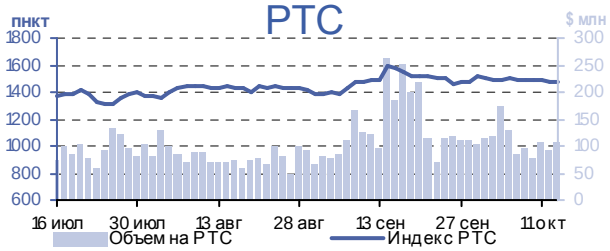
16 октября 2012г.

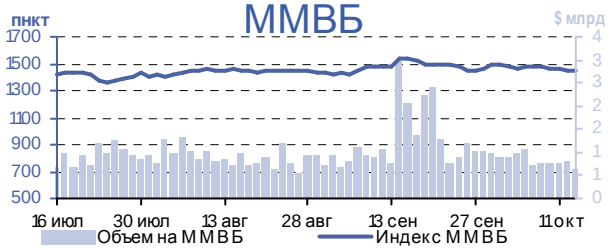
## Комментарий по рынку акций

Никаких весомых движений в наших фондовых индексах вчера мы не увидели. Российский рынок акций сохраняет низкие обороты, невысокую ликвидность и волатильность. Крупные местные игроки в понедельник вечером легко опустили индекс РТС к минимальным 2-х недельным уровням, сформировав приемлемую цену экспирации по коротким октябрьским опционным контрактам. Если не учитывать короткий резкий взлет котировок, когда ФРС объявила о запуске QE-3, можно считать, что индекс ММВБ уже 2,5 месяца торгуется в зоне консолидации. Текущая отметка 1445 п. – уровень начала августа.

*Полный текст на 2 стр.*

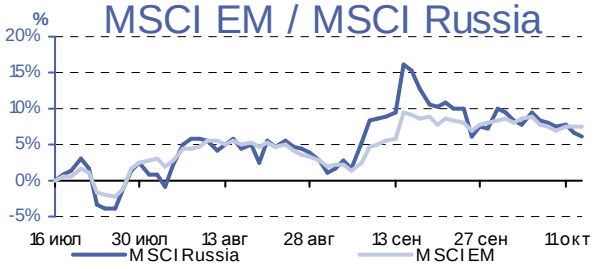
## Основные индикаторы




## Значение основных индексов

| | Значение | Δ, день | Δ, нед | Δ, мес | Δ, ytd |
|---|---|---|---|---|---|
| Индекс РТС | 1 466,82 | -0,38% | -1,72% | -7,71% | 2,77% |
| Индекс ММВБ | 1 443,42 | -0,18% | -2,05% | -5,99% | 2,88% |
| FTSE | 5 805,61 | 0,21% | -0,62% | -1,86% | 6,79% |
| S&P 500 | 1 440,13 | 0,81% | -1,08% | -1,75% | 19,92% |
| Dow Jones Avg. | 13 424,23 | 0,72% | -1,17% | -1,24% | 17,79% |




## Лидеры снижения

| | Цена | Δ, день | Δ, мес | Δ, ytd |
|---|---|---|---|---|
| Фармстандарт | 45,0000 | -2,17% | -7,60% | -18,63% |
| Сбербанк | 2,9490 | -1,54% | -7,41% | 13,21% |

## Индекс *MSCI*

| | Значение | Δ, день | Δ, мес | Δ, ytd |
|---|---|---|---|---|
| Индекс MSCI EM | 995,22 | -0,15% | -1,86% | 5,76% |
| Индекс MSCI BRAZIL | 2691,86 | 0,61% | -4,45% | -5,13% |
| Индекс MSCI RUSSIA | 783,97 | -0,32% | -8,53% | 4,81% |
| Индекс MSCI INDIA | 424,19 | -0,20% | 4,65% | 0,99% |
| Индекс MSCI CHINA | 57,31 | -0,04% | 3,40% | 7,38% |

# Обзор рынка

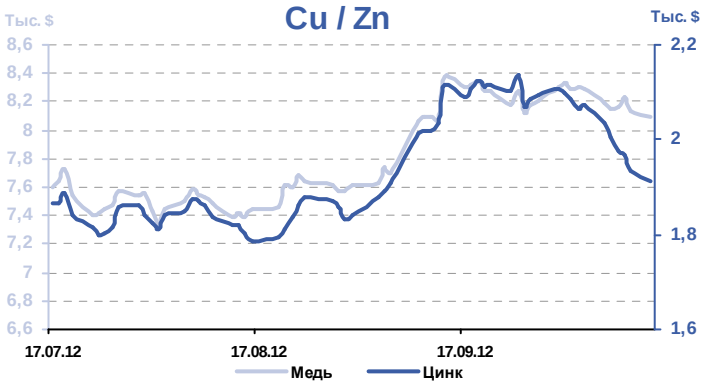
Никаких весомых движений в наших фондовых индексах вчера мы не увидели. Российский рынок акций сохраняет низкие обороты, невысокую ликвидность и волатильность. Крупные местные игроки в понедельник вечером легко опустили индекс РТС к минимальным 2-х недельным уровням, сформировав приемлемую цену экспирации по коротким октябрьским опционным контрактам. Если не учитывать короткий резкий взлет котировок, когда ФРС объявила о запуске QE-3, можно считать, что индекс ММВБ уже 2,5 месяца торгуется в зоне консолидации. Текущая отметка 1445 п. – уровень начала августа.

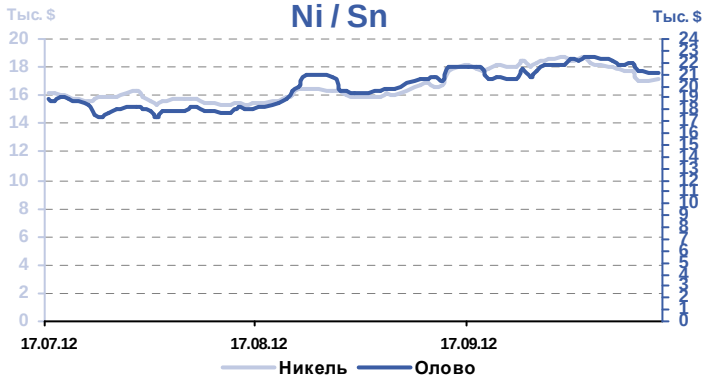
Во вторник мы ждем открытия торгов на наших фондовых биржах с гэпом вверх чуть более полпроцента. Характерным внутридневным поведением наших индексов за последнюю неделю стал сценарий утреннего подъема и вечерних продаж. С учетом того, что со сцены ушел фактор экспирации есть надежда на то, что сегодня индексу ММВБ удастся пойти выше локальных максимумов последних дней (1456, 1460, 1468 п.). В качестве факторов поддержки сегодня выступают: выросшие цены на нефть, сильное закрытие торгов в Америке, зеленеющие азиатские индексы (MSCI Asia +0,68%), а также ряд других косвенных признаков.

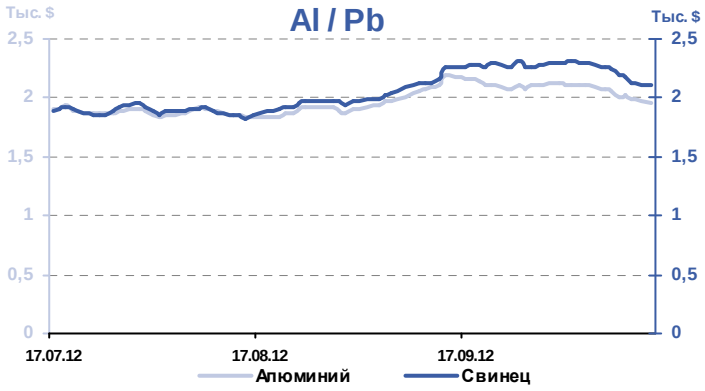
Вчера индексы США показательно двинулись вверх от наклонного уровня поддержки, на фоне благоприятной статистики по розничным продажам и квартальной отчетности Citigroup (+5,5%). Сегодня ждем отчетов от ряда крупных американских корпораций: Coca-Cola; Goldman Sachs, Intel Corp., IBM, Johnson & Johnson, Rio Tinto, Xstrata. Сегодня последний день обращения ноябрьских фьючерсов на нефть марки Brent и на утро вторника его котировки поднялись до $115,8/барр. Этот фактор сегодня толкнет вверх цены на акции Газпрома и других энергетических компаний.

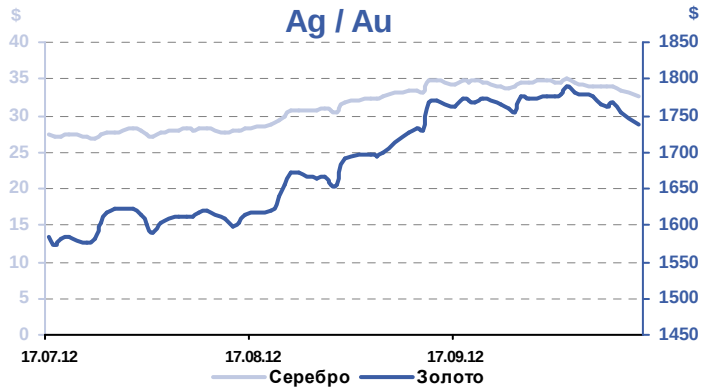
Сегодня в 13-00 в еврозоне выходят данные по потребительской инфляции за сентябрь. В это же время в Германии выходят экономические индексы ZEW за октябрь. В 16-30 из США ждем публикации индекса потребительских цен. В 17-15 выходит статистика по объемам промышленного производства и загрузки производственных мощностей за сентябрь. В ночь со вторника на среду в США пройдут очередные президентские дебаты между Б. Обама и М. Ромни.

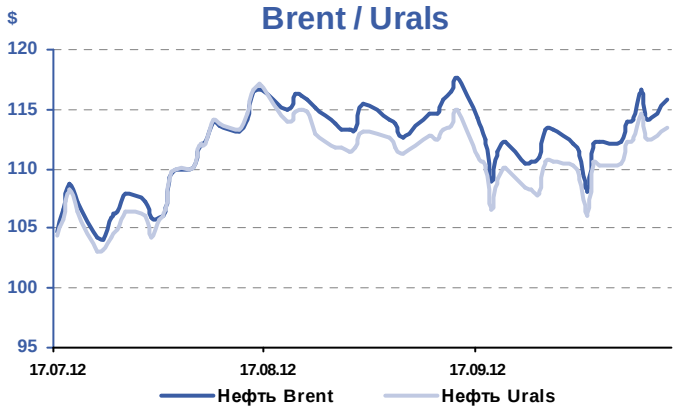
# Commodities

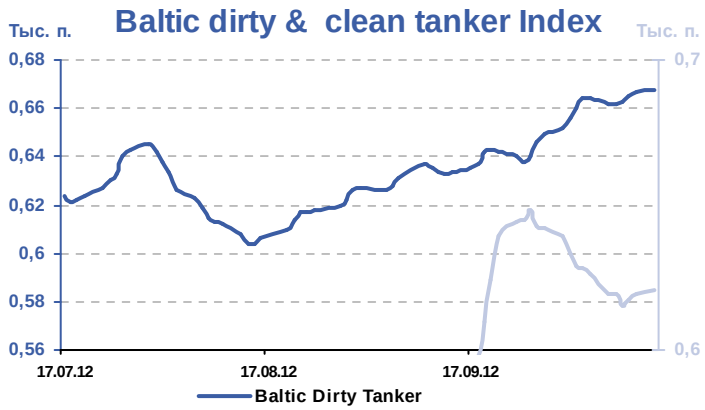



## Основные товары, *SPOT (LSE, NYSE*

| | Значение | Δ за день, % | Δ за нед,% | Δ за мес,% | Δ ytd,% |
|---|---|---|---|---|---|
| Медь, $/t | 8 094,50 | -0,44% | -1,11% | -3,41% | 8,00% |
| Цинк, $/t | 1 914,50 | -1,06% | -5,88% | -9,52% | 0,50% |
| Никель, $/t | 17 095,00 | 0,12% | -5,42% | -3,83% | -9,91% |
| Олово, $/t | 21 095,00 | -1,03% | -4,55% | -2,68% | -1,86% |
| Алюминий, $/t | 1 963,00 | -1,55% | -5,74% | -10,77% | -11,42% |
| Свинец, $/t | 2 106,00 | -1,17% | -6,81% | -7,02% | 6,07% |
| Серебро, $/oz | 32,72 | -2,37% | -3,72% | -5,60% | 2,91% |
| Золото, $/oz | 1 737,55 | -0,96% | -2,11% | -1,86% | 3,99% |
| Нефть Brent, $/ | 115,80 | 1,39% | 3,17% | -1,52% | 3,69% |
| Нефть Urals, $/ | 113,52 | 0,99% | 2,81% | -1,29% | 1,84% |

# Российский рынок акций

| Эмитент | Тикер | Цена закрытия, $ | Δ РТС | Δ ММВБ | Объем на РТС, $ | Объем на ММВБ, $ | Капитализация, m$ |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ОАО ТНК-ВР Холдинг | TNBP | 2,702 | 0,00% | 0,00% | 27 024 | | 40 528 |
| **Нефть и газ** | | | | | | | |
| Башнефть | BANE | 59,000 | 0,00% | 0,00% | 29 500 | | 10 040 |
| Газпром | GAZP | 5,010 | 0,00% | 0,00% | 250 500 | | 118 604 |
| Лукойл | LKOH | 61,900 | 0,00% | 0,00% | 309 500 | | 52 650 |
| Мегионнефтегаз | MFGS | 14,650 | 0,00% | 0,00% | 5 508 | | 1 457 |
| Сургутнефтегаз, п. | SNGSP | 0,670 | 0,00% | 0,00% | 67 000 | | 5 160 |
| Татнефть | TATN | 6,930 | 0,00% | 0,00% | 345 750 | | 15 098 |
| Татнефть, п. | TATNP | 3,460 | 0,00% | 0,00% | 17 300 | | 510 |
| Транснефть, п. | TRNFP | 1833,621 | 0,00% | 0,00% | 33 005 | | 2 851 |
| **Электроэнергетика** | | | | | | | |
| ОГК-2 | OGKB | 0,013 | 0,00% | 0,00% | 11 889 | | 1 083 |
| ТГК-3 | MSNG | 0,046 | 0,00% | 0,00% | 6 344 | | 1 813 |
| ТГК-5 | TGKE | 0,000 | 0,00% | 0,00% | 2 081 | | 135 |
| ТГК-6 | TGKF | 0,000 | 0,00% | 0,00% | 1 156 | | 186 |
| **Телекоммуникации** | | | | | | | |
| Ростелеком, п. | RTKMP | 3,043 | 0,00% | 0,00% | 21 908 | | 739 |
| **Машиностроение** | | | | | | | |
| ГАЗ | GAZA | 30,500 | 0,00% | 0,00% | 4 575 | | 565 |
| Северсталь-авто | SVAV | 21,472 | 0,00% | 0,00% | 7 644 | | 736 |
| **Металлургия** | | | | | | | |
| НорНикель | GMKN | 167,921 | 0,00% | 0,00% | 33 584 | | 32 010 |
| Полюс Золото | PLZL | 34,300 | 0,00% | 0,00% | 35 329 | | 6 539 |
| Северсталь | CHMF | 12,698 | 0,00% | 0,00% | 12 698 | | 10 637 |
| **Банки** | | | | | | | |
| Возрождение | VZRZ | 19,520 | 0,00% | 0,00% | 46 188 | | 464 |
| Сбербанк | SBER | 2,949 | -1,54% | 0,00% | 3 645 096 | | 63 660 |
| **Транспорт** | | | | | | | |
| Дальневосточное МП | FESH | 0,315 | 0,00% | 0,00% | 31 500 | | 930 |
| **Потребительский рынок** | | | | | | | |
| Дикси | DIXY | 11,000 | 1,10% | 0,00% | 220 000 | | 1 372 |
| Магнит | MGNT | 143,500 | 0,00% | 0,00% | 286 500 | | 13 570 |
| Разгуляй | GRAZ | 0,453 | 0,00% | 0,00% | 6 795 | | 72 |
| Фармстандарт | PHST | 45,000 | -2,17% | 0,00% | 10 035 | | 1 701 |
| **Химическая промышленность** | | | | | | | |
| Акрон | AKRN | 45,113 | 0,00% | 0,00% | 7 669 | | 1 829 |
| **Уголь** | | | | | | | |
| Распадская | rasp | 2,360 | 0,00% | 0,00% | 165 200 | | 1 843 |

*Источник: РТС, Bloomberg*

# Российские *ADR/GDR*

| Эмитент | Тикер | Акций в АДР | Валюта торгов | Цена закрытия | Изменение, % | Объем, k$ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Аэрофлот | AETG | | EUR | 104,617 | -0,85% | |
| Башнефть | AK6 | | EUR | 232,000 | 4,10% | |
| ALPHABANKSPONSADR | ALBKY | | USD | 0,610 | 13,93% | 14,72 |
| ТГК-3 | AOMD | | USD | 2,260 | 0,00% | 49,77 |
| Татнефть | ATAD | | USD | 40,650 | 1,57% | 9 438,81 |
| АвтоВАЗ | AVVG | | EUR | 1,858 | -1,33% | |
| X5 | FIVE | | USD | 19,000 | -1,71% | 11 566,86 |
| Газпром | GAZ | | EUR | 7,555 | 0,29% | 830,48 |
| ГолденТелеком | GLDN | 1 | USD | 0,013 | -3,70% | 0,05 |
| Кузбассэнерго | KUW | | EUR | 1,700 | 0,00% | |
| Лукойл | LKOD | | USD | 61,850 | -0,32% | 177 379,80 |
| Лукойл | LUK | | EUR | 47,658 | -0,54% | 197,44 |
| Лукойл | LUKOY | 1 | USD | 62,310 | 0,49% | 1 287,27 |
| МТС | MBT | 5 | USD | 17,170 | 0,23% | 28 832,50 |
| МТС | MKY | 5 | EUR | 13,185 | -0,75% | |
| ТГК-3 | MRO | | EUR | 1,920 | 10,41% | 6,59 |
| Мечел | MTL | 3 | USD | 6,720 | -1,32% | 25 425,98 |
| НорНикель | NILSY | 1 | USD | 15,680 | 0,64% | 969,63 |
| НорНикель | NNIA | | EUR | 12,035 | 0,80% | 46,46 |
| НОВАТЭК | NVTK | 1 | USD | 120,800 | -0,41% | 20 411,06 |
| Nizhnednepr.tubeRoll.Plant | NYZ | | EUR | 1,038 | 0,00% | |
| Нижнекамскнефтехим | OAO | | EUR | 6,975 | 0,36% | 7,10 |
| Газпром | OGZD | | USD | 9,735 | -0,56% | 131 464,20 |
| ОМЗ | OMZD | | USD | 1,200 | 0,00% | |
| Ростелеком | RKMD | | USD | 25,680 | -0,08% | 1 204,52 |
| Ростелеком | RTL | | EUR | 19,835 | 0,38% | 0,79 |
| Газпромнефть | SCF | | EUR | 19,650 | 1,84% | 45,48 |
| Сургутнефтегаз | SGN | | EUR | 7,020 | 0,11% | |
| Сургутнефтегаз | SGNY | | EUR | 5,134 | -1,25% | 1,79 |
| Сургутнефтегаз | SGTPY | | USD | 6,700 | 0,00% | 530,80 |
| Сургутнефтегаз | SGTZY | 50 | USD | 9,150 | 0,22% | 2,83 |
| АФКСистема | SSA | 1 | USD | 19,700 | -1,01% | 12 078,59 |
| SunInterbrewLtd | SUG | | EUR | 5,691 | -2,45% | |
| SunInterbrewLtdpr. | SUGA | | EUR | 2,104 | -0,24% | |
| СТЗ | SVY | | EUR | 25,000 | -9,42% | |
| Ukrnafta | UKAA | | EUR | 77,000 | -0,07% | |
| Вымпелком | VIP | 1 | EUR | 11,240 | -1,32% | 14 440,03 |
| ВТБ | VTBR | | USD | 3,417 | -0,44% | 52 325,33 |
| Возрождение | VZY | | EUR | 14,500 | 0,00% | |

*Источник: Bloomberg*

# Аналитическая служба «Ай Ти Инвест - Проспект»

Александр Потавин
Начальник отдела, рыночный анализ

Ольга Самарец
Потребительский сектор

Солодин Дмитрий
Ситуационный анализ

Егишянц Сергей
Макроэкономика, мировые рынки

Наумов Александр
электроэнергетика

# Трейдинг

**+ 7 (495) 937 33 63**

Лобанов Александр
Начальник отдела
*lobjr@prospect.com.ru*

Билялов Энвер
*bilyalov@prospect.com.ru*

Кузнецова Ирина
*kuznetsova@prospect.com.ru*

Хмельник Михаил
*hop@prospect.com.ru*

Бохин Александр
*abokhin@prsp.ru*

Зуев Дмитрий
*zouev@prospect.com.ru*

Сильвестров Кирилл
*ksilvestrov@prsp.ru*

# Брокерская группа «Ай Ти Инвест -Проспект»

Россия, Москва, 119180, 1-ый Голутвинский переулок, д. 6
телефон: +7 (495) 937 33 63
факс: +7 (495) 937 33 60

***www.prsp.ru***
***www.itinvest.ru***

Представленная информация базируется на достоверных источниках.
Тем не менее, содержание данного аналитического обзора может использоваться только в информационных целях.
ОАО "ИК "Проспект" и ОАО "ИК "Ай Ти Инвест" не несут ответственности за точность предоставленных данных.
Данный документ не является предложением на покупку или продажу каких-либо ценных бумаг.
Он также не является рекомендацией на покупку или продажу ценных бумаг, упомянутых в отчете.
Компании и ее сотрудники, включая тех, кто готовил этот отчет, могут иметь позиции, а также покупать и продавать ценные бумаги упомянутых в отчете компаний.
Инвестирование в странах СНГ является исключительно рискованным, поэтому инвесторы должны самостоятельно тщательно проработать свое решение.

Все права на данный аналитический отчет принадлежат Брокерской группе "Ай Ти Инвест - Проспект".
Перепечатка целиком или отдельными частями без ссылки на компании не допускается.